

공시일	2018-06-26
기준일	2018-06-25

## 포커스농산물모(채권-파생평)

### 1. 계약금액

(단위:USD 백만)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	지수	스왑	0	0	0	장외
누계	지수	스왑	7	0	7	장외

### 2. 만기시점의 손익구조

### 3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

\* 해당펀드는 위험지표산출에 어려움이 있어 공시하지 않음

### 4. 파생상품의 최대손실예상금액(VaR : 99%신뢰수준,10일기준)

\* 해당펀드는 위험지표산출에 어려움이 있어 공시하지 않음



4. 파생상품의 최대손실예상금액(VaR : 99%신뢰수준,10일기준)

(단위:백만원)

72

공시일	2018-06-26
기준일	2018-06-25

## SMART합성-MSCI선진국증권상장지

### 1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	지수	스왑	0	0	0	장외
누계	지수	스왑	14,040	0	14,040	장외

### 2. 만기시점의 손익구조

#### 3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

SWMXWO0( 신한MXWO 미래S180523

1,118

\* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대응치가 사용되었음

#### 4. 파생상품의 최대손실예상금액(VaR : 99%신뢰수준,10일기준)

(단위:백만원)

463

\* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대응치가 사용되었음

공시일	2018-06-26
기준일	2018-06-25

## SMART중국본토중소형CSI500상장

### 1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	지수	스왑	0	0	0	장외
누계	지수	스왑	4,755	0	4,755	장외

### 2. 만기시점의 손익구조

### 3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

SWCSI500000 신한CSI500미래S180608

332

\* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대응치가 사용되었음

### 4. 파생상품의 최대손실예상금액(VaR : 99%신뢰수준,10일기준)

(단위:백만원)

388

\* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대응치가 사용되었음

공시일	2018-06-26
기준일	2018-06-25

## 유로인덱스모(주식-파생형)

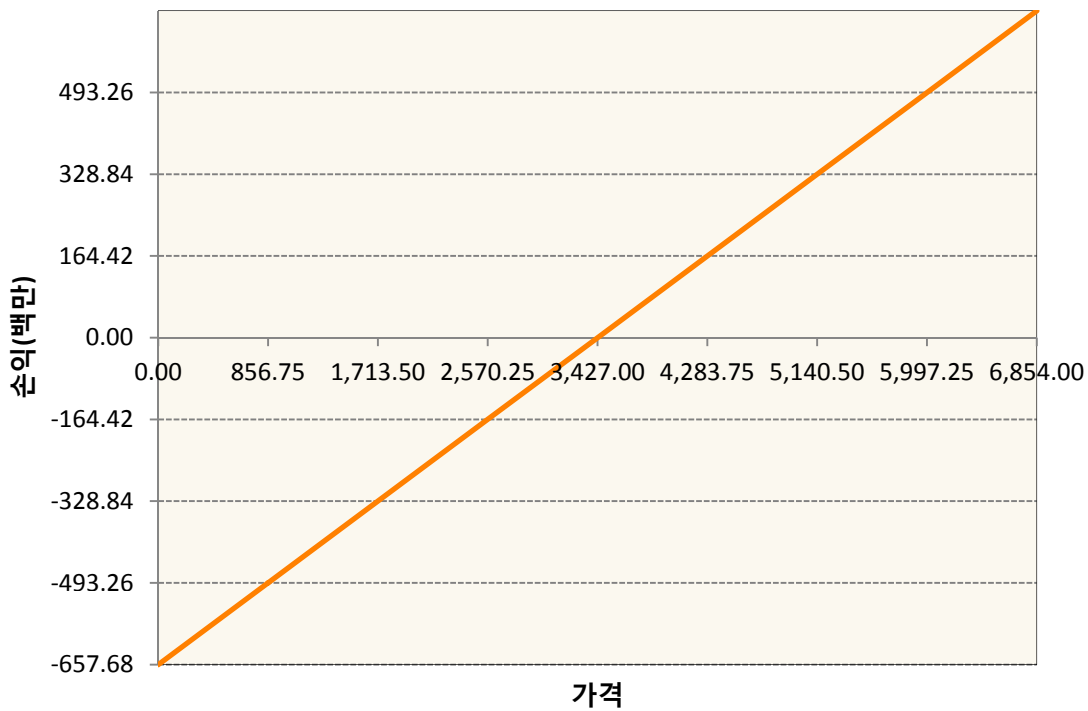
### 1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	유가증권	선물	658	0	658	

### 2. 만기시점의 손익구조

VGU8-EURO STOXXX 50 SEP18



### 3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

VGU8	EURO STOXXX 50 SEP18	53
------	----------------------	----

### 4. 파생상품의 최대손실예상금액(VaR : 99%신뢰수준,10일기준)

(단위:백만원)

33
----

공시일	2018-06-26
기준일	2018-06-25

## 차이나인덱스모(주식-파생형)

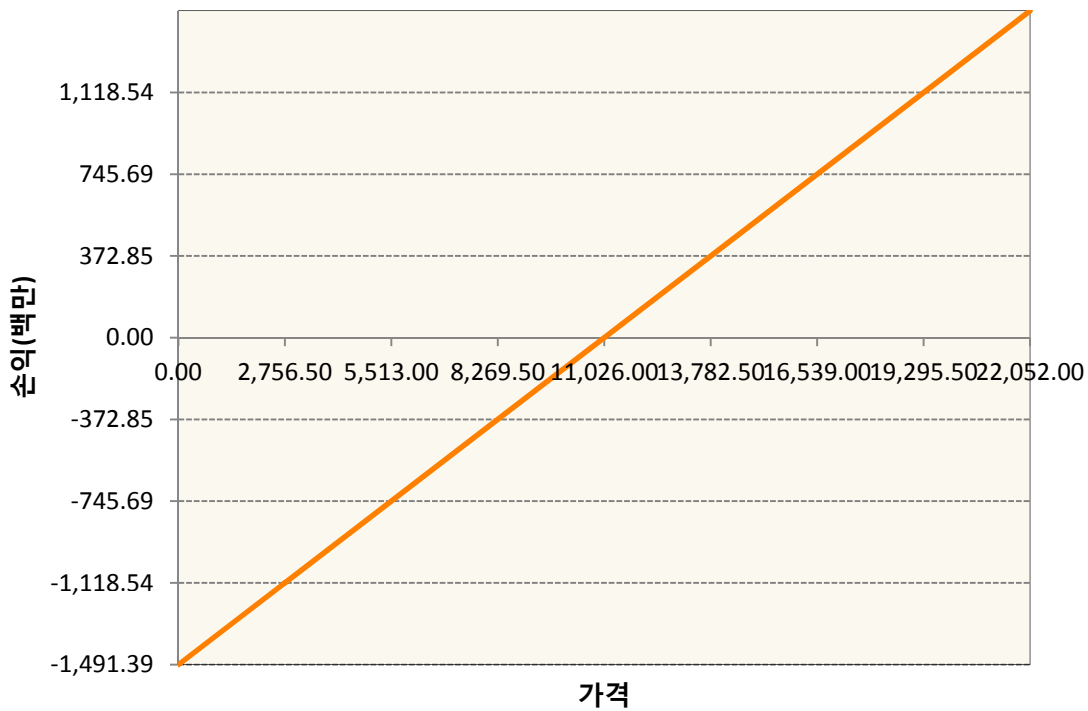
### 1. 계약금액

(단위:백만원)

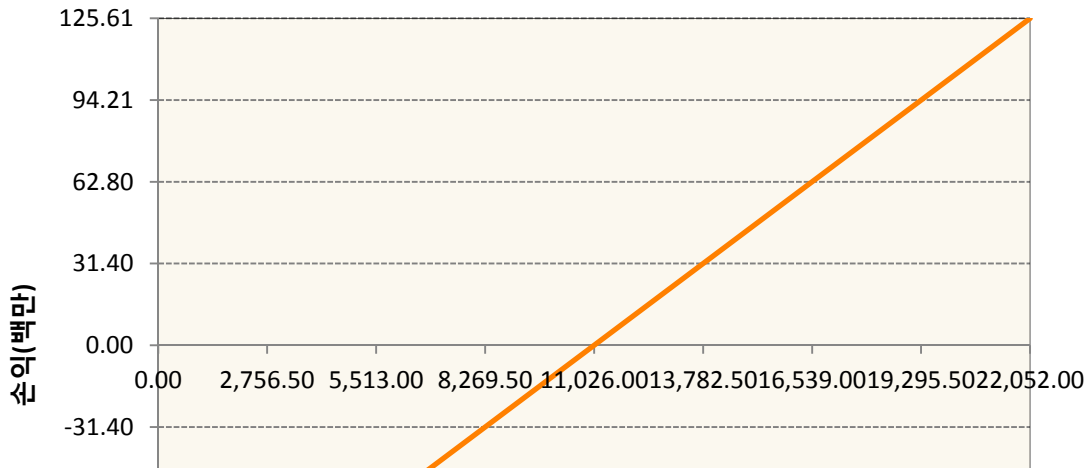
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	1,617	0	1,617	장내

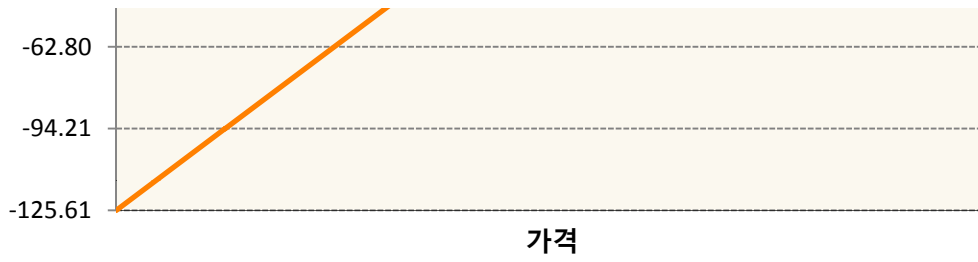
### 2. 만기시점의 손익구조

HCN8-HSCEI Futures Jul18



MHCN8-MINI H-SHR IDX FU JUL18





**3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)** (단위:백만원)

HCN8	HSCEI Futures Jul18	119
MHCN8	MINI H-SHR IDX FU JUL18	10

**4. 파생상품의 최대손실예상금액(VaR : 99%신뢰수준,10일기준)** (단위:백만원)

<b>116</b>
------------

공시일	2018-06-26
기준일	2018-06-25

## 커버드콜모(주식혼합-파생형)

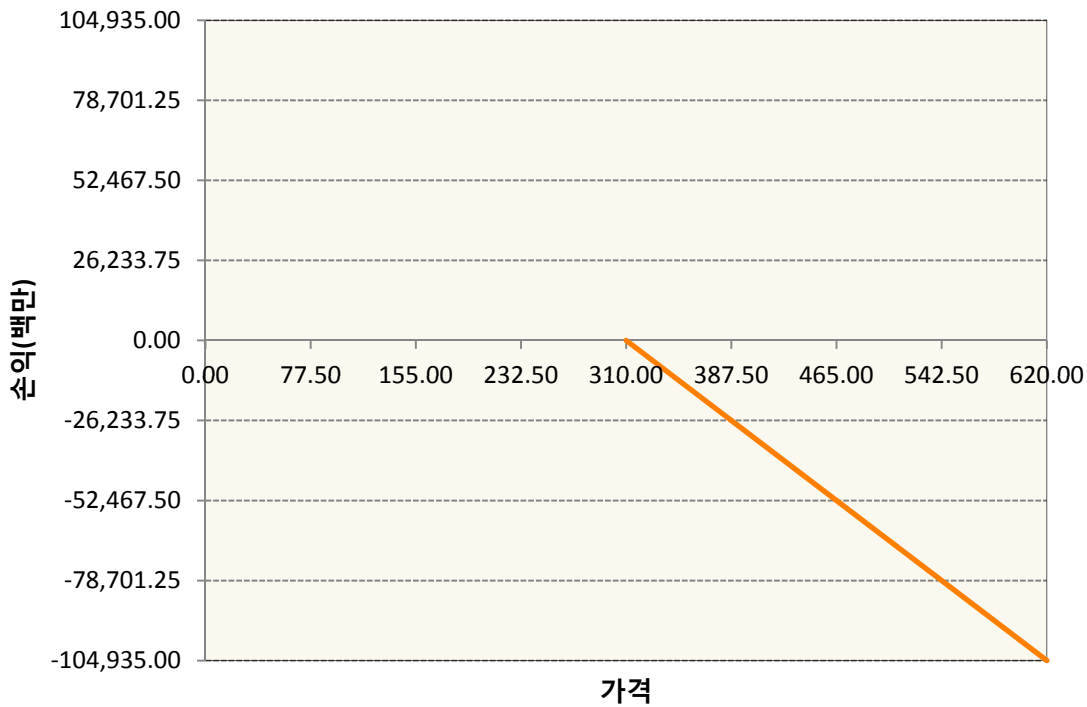
### 1. 계약금액

(단위:백만원)

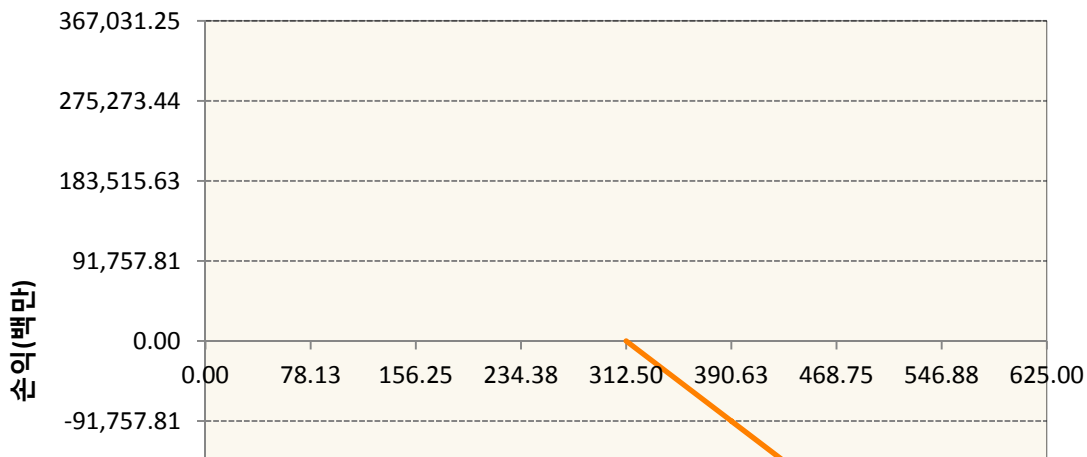
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	옵션	0	0	0	장내
누계	유가증권	옵션	0	471,966	-471,966	장내

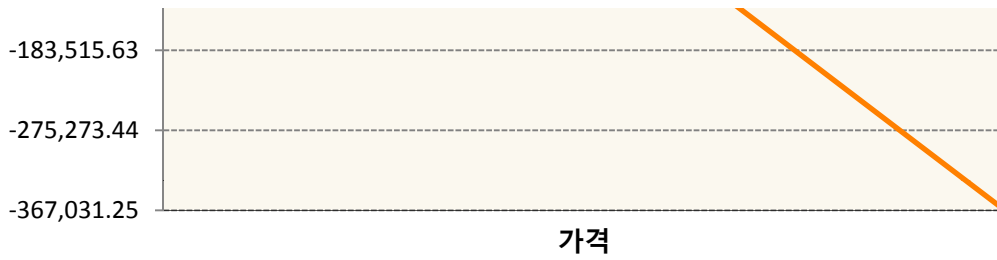
### 2. 만기시점의 손익구조

**KR4201N73109-2018-07 콜310**



**KR4201N73125-2018-07 콜312.5**





**3. 시나리오 별 손익구조변동(최대손실예상금액)** (단위:백만원)

KR4201N7312018-07 콜310 5,541

기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	1,692	1,665	1,626	1,573	1,508	1,431	1,343
-5.33%	1,595	1,522	1,434	1,331	1,215	1,088	952
-2.67%	1,300	1,159	1,005	842	670	493	310
0%	626	420	211	0	-213	-428	-644
2.67%	-583	-810	-1,036	-1,263	-1,490	-1,717	-1,944
5.33%	-2,355	-2,549	-2,749	-2,954	-3,162	-3,374	-3,587
8.00%	-4,582	-4,713	-4,858	-5,016	-5,183	-5,359	-5,541

KR4201N7312018-07 콜312.5 18,089

기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	4,924	4,856	4,751	4,606	4,419	4,191	3,923
-5.33%	4,692	4,493	4,239	3,935	3,585	3,194	2,766
-2.67%	3,926	3,505	3,035	2,524	1,981	1,409	814
0%	2,044	1,381	698	0	-711	-1,431	-2,159
2.67%	-1,552	-2,342	-3,133	-3,925	-4,716	-5,507	-6,299
5.33%	-7,112	-7,843	-8,587	-9,340	-10,100	-10,866	-11,637
8.00%	-14,394	-14,928	-15,504	-16,114	-16,751	-17,411	-18,089

**4. 파생상품의 최대손실예상금액(VaR : 99%신뢰수준,10일기준)** (단위:백만원)

**21,061**

공시일	2018-06-26
기준일	2018-06-25

## 홍콩H커버드콜모(주식혼합-파생)

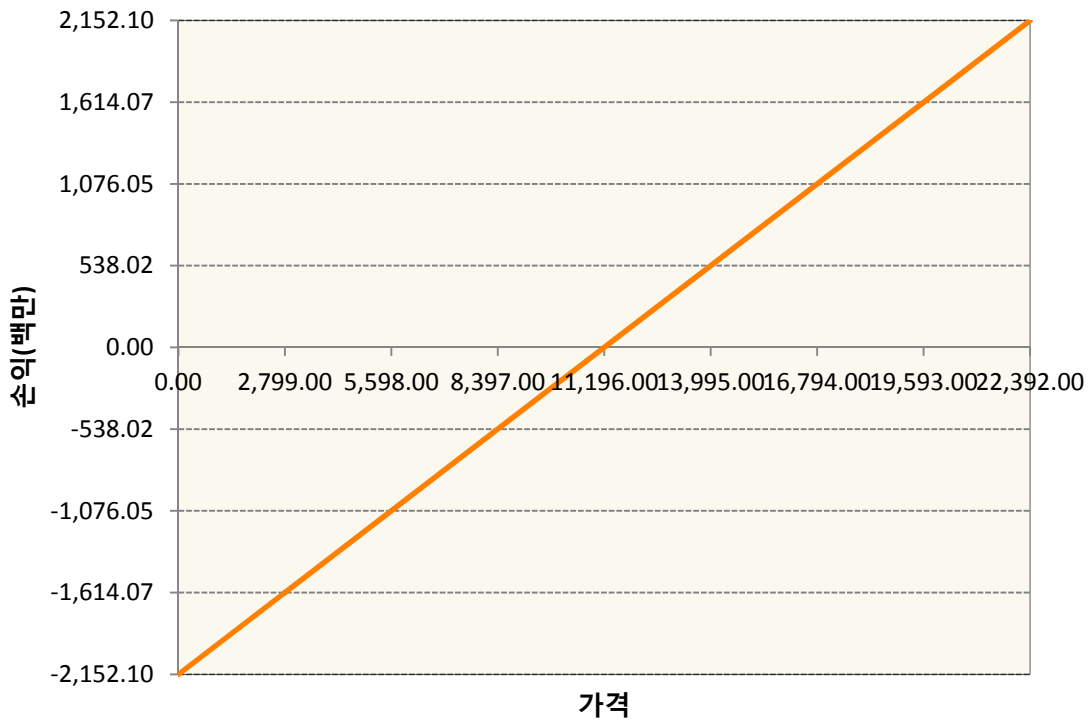
### 1. 계약금액

(단위:백만원)

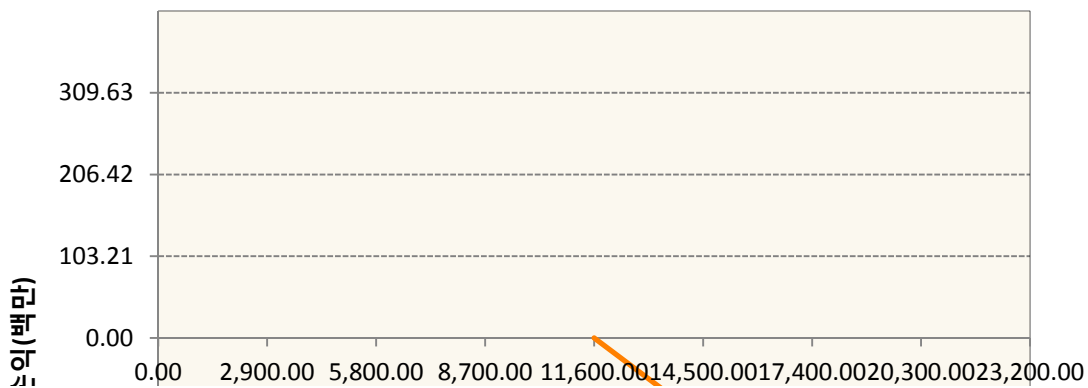
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
신규	유가증권	옵션	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	2,152	0	2,152	장내
누계	유가증권	옵션	0	6,033	-6,033	장내

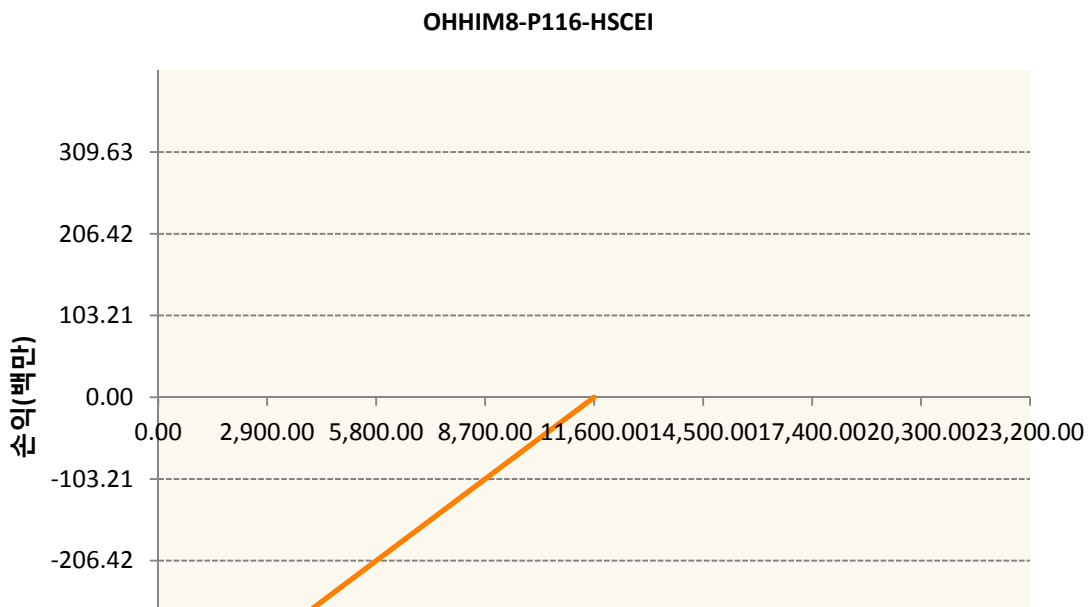
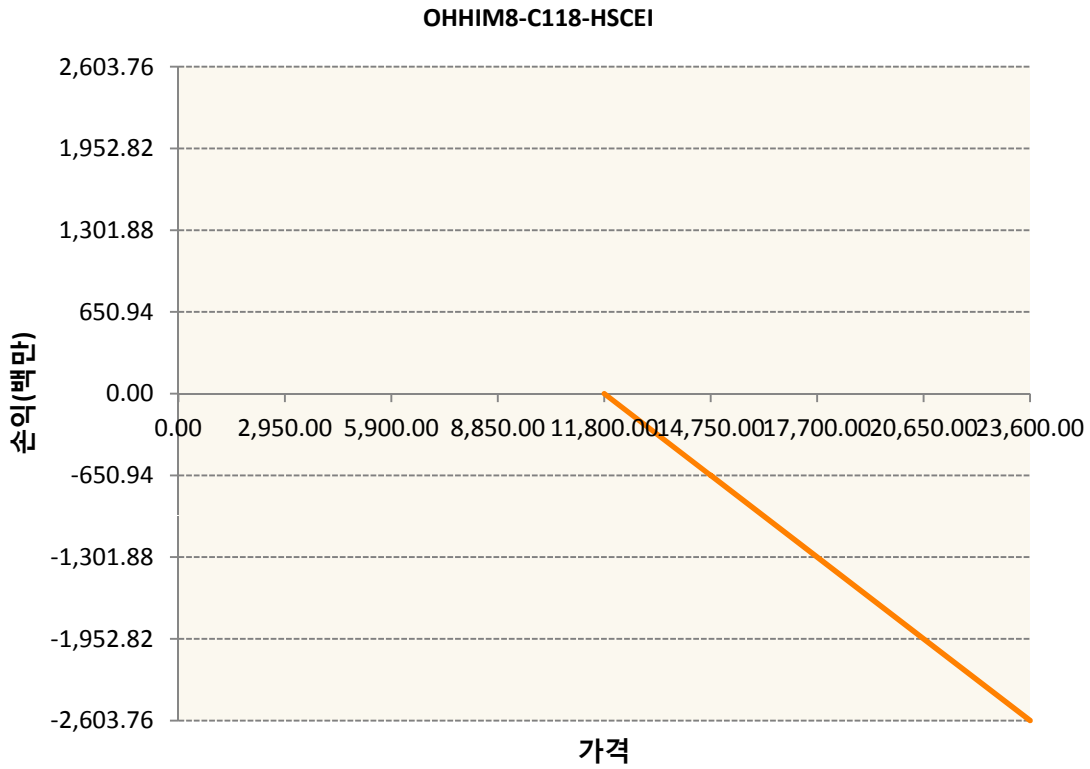
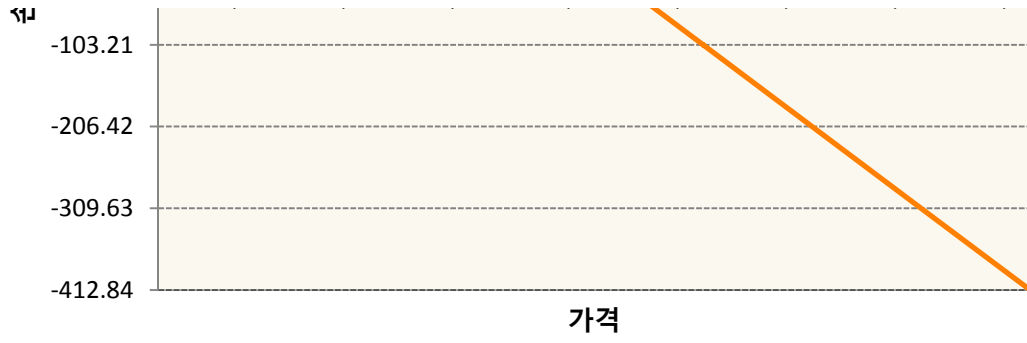
### 2. 만기시점의 손익구조

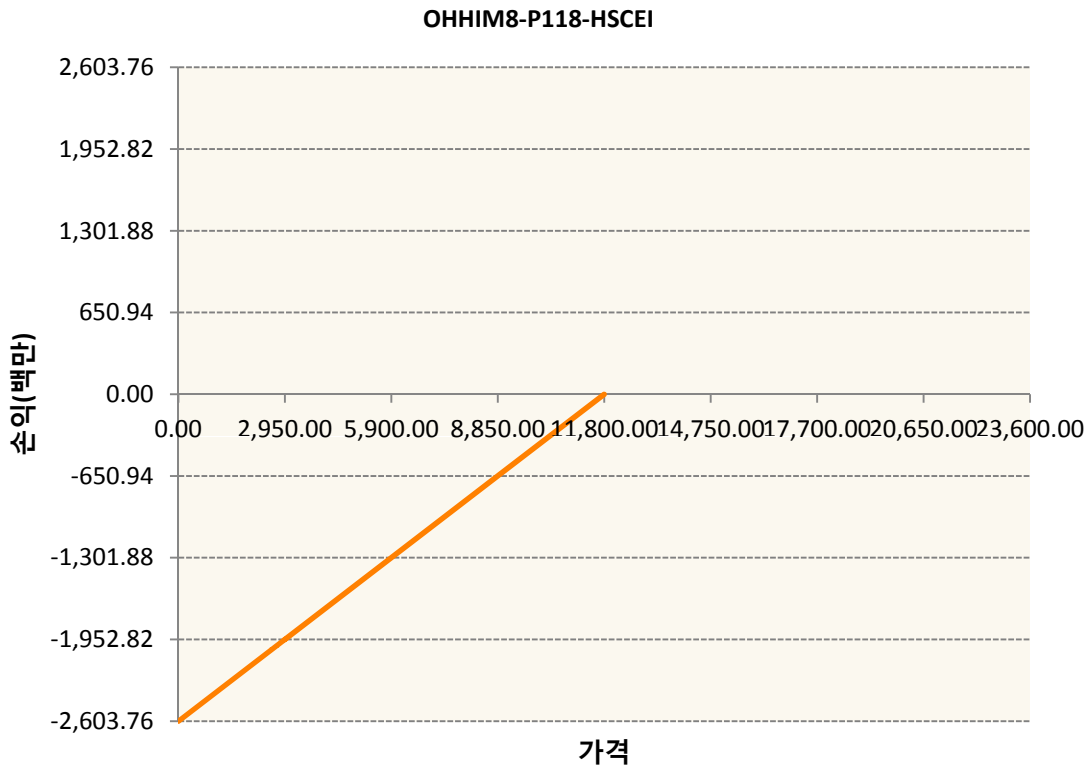
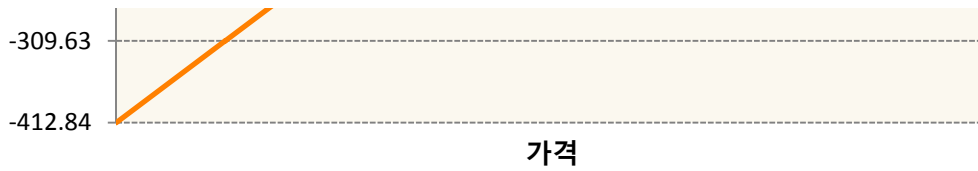
HCM8-HSCEI Futures Jun18



OHHIM8-C116-HSCEI







3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)		(단위:백만원)
HCM8	HSCEI Futures Jun18	172
OHHIM8-C1	HSCEI	33
OHHIM8-C1	HSCEI	208
OHHIM8-P1	HSCEI	33
OHHIM8-P1	HSCEI	208

4. 파생상품의 최대손실예상금액(VaR : 99%신뢰수준,10일기준)	(단위:백만원)
	586

공시일	2018-06-26
기준일	2018-06-25

## 코리아듀얼엔진커버드콜(주식혼)

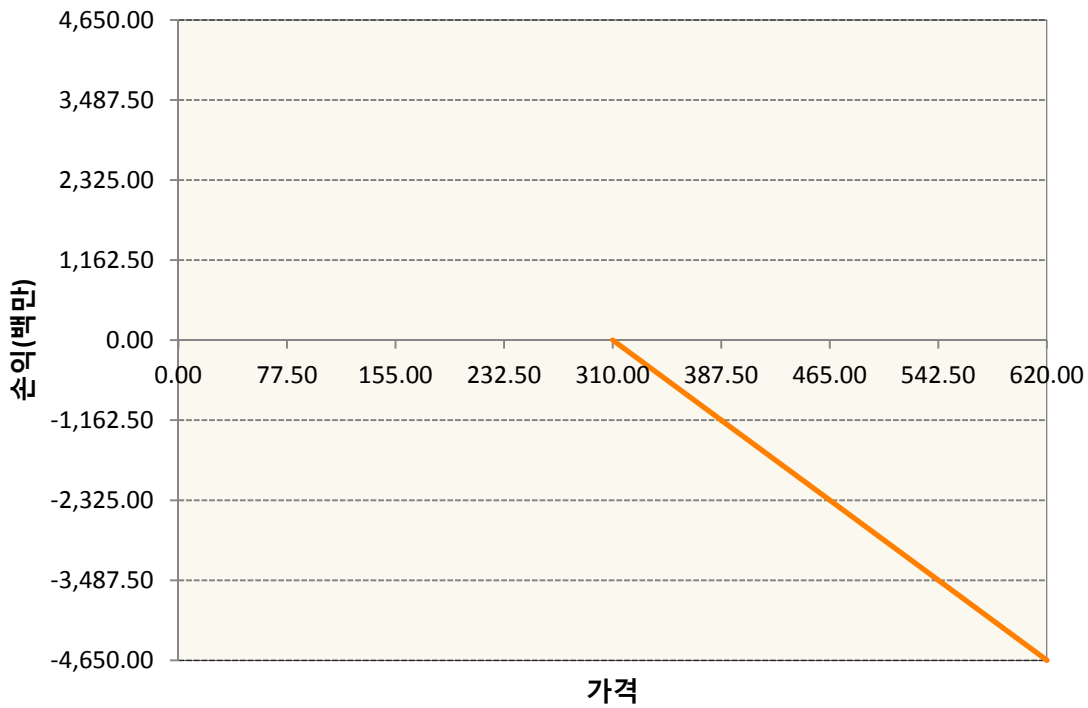
### 1. 계약금액

(단위:백만원)

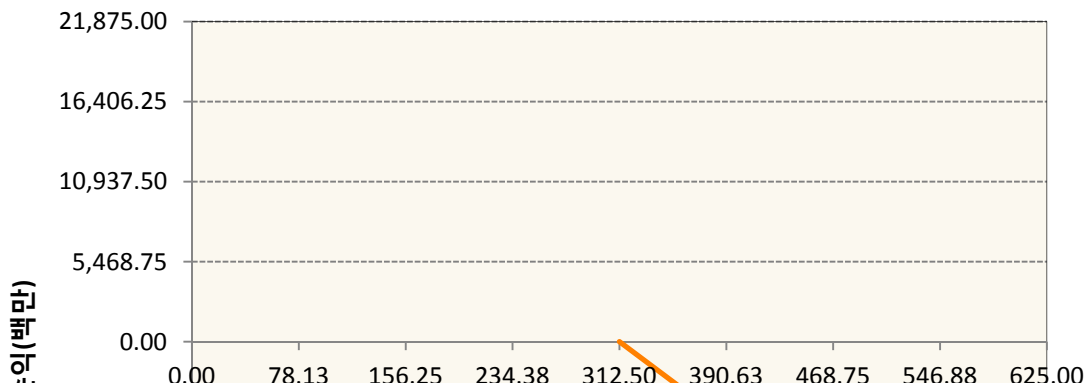
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	스왑	0	0	0	장외
신규	유가증권	옵션	0	0	0	장내
누계	유가증권	스왑	48,200	0	48,200	장외
누계	유가증권	옵션	0	26,525	-26,525	장내

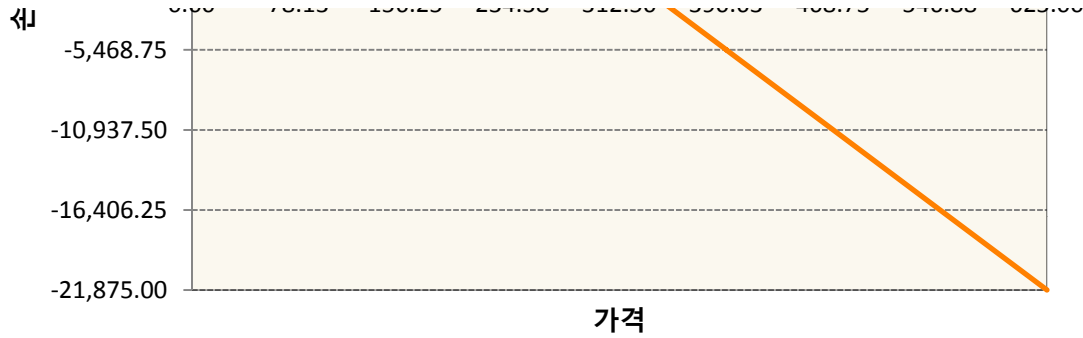
### 2. 만기시점의 손익구조

KR4201N73109-2018-07 콜310



KR4201N73125-2018-07 콜312.5





**3. 시나리오 별 손익구조변동(최대손실예상금액)** (단위:백만원)

2.529E+11 UBCSFXC1 INDEX_2							1,497
기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-1,497	-1,497	-1,497	-1,497	-1,497	-1,497	-1,497
-5.33%	-998	-998	-998	-998	-998	-998	-998
-2.67%	-499	-499	-499	-499	-499	-499	-499
0%	0	0	0	0	0	0	0
2.67%	499	499	499	499	499	499	499
5.33%	998	998	998	998	998	998	998
8.00%	1,497	1,497	1,497	1,497	1,497	1,497	1,497
2.529E+11 UBCSFXC1 INDEX_3							283
기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-283	-283	-283	-283	-283	-283	-283
-5.33%	-189	-189	-189	-189	-189	-189	-189
-2.67%	-94	-94	-94	-94	-94	-94	-94
0%	0	0	0	0	0	0	0
2.67%	94	94	94	94	94	94	94
5.33%	189	189	189	189	189	189	189
8.00%	283	283	283	283	283	283	283
2.529E+11 UBCSFXC1 INDEX_5							243
기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-243	-243	-243	-243	-243	-243	-243
-5.33%	-162	-162	-162	-162	-162	-162	-162
-2.67%	-81	-81	-81	-81	-81	-81	-81
0%	0	0	0	0	0	0	0
2.67%	81	81	81	81	81	81	81
5.33%	162	162	162	162	162	162	162
8.00%	243	243	243	243	243	243	243
2.529E+11 UBCSFXC1 INDEX_7							259
기초자산의 변동성							

가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-259	-259	-259	-259	-259	-259	-259
-5.33%	-173	-173	-173	-173	-173	-173	-173
-2.67%	-86	-86	-86	-86	-86	-86	-86
0%	0	0	0	0	0	0	0
2.67%	86	86	86	86	86	86	86
5.33%	173	173	173	173	173	173	173
8.00%	259	259	259	259	259	259	259

2.529E+11 UBCSFXC1 INDEX\_8

479

기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-479	-479	-479	-479	-479	-479	-479
-5.33%	-319	-319	-319	-319	-319	-319	-319
-2.67%	-160	-160	-160	-160	-160	-160	-160
0%	0	0	0	0	0	0	0
2.67%	160	160	160	160	160	160	160
5.33%	319	319	319	319	319	319	319
8.00%	479	479	479	479	479	479	479

2.529E+11 UBCSFXC1 INDEX\_11

647

기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-647	-647	-647	-647	-647	-647	-647
-5.33%	-432	-432	-432	-432	-432	-432	-432
-2.67%	-216	-216	-216	-216	-216	-216	-216
0%	0	0	0	0	0	0	0
2.67%	216	216	216	216	216	216	216
5.33%	432	432	432	432	432	432	432
8.00%	647	647	647	647	647	647	647

2.529E+11 UBCSFXC1 INDEX\_12

486

기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-486	-486	-486	-486	-486	-486	-486
-5.33%	-324	-324	-324	-324	-324	-324	-324
-2.67%	-162	-162	-162	-162	-162	-162	-162
0%	0	0	0	0	0	0	0
2.67%	162	162	162	162	162	162	162
5.33%	324	324	324	324	324	324	324
8.00%	486	486	486	486	486	486	486

KR4201N7312018-07 콜310

246

기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	75	74	72	70	67	63	60
-5.33%	71	67	64	59	54	48	42
-2.67%	58	51	45	37	30	22	14

0%	28	19	9	0	-9	-19	-29
2.67%	-26	-36	-46	-56	-66	-76	-86
5.33%	-104	-113	-122	-131	-140	-149	-159
8.00%	-203	-209	-215	-222	-230	-237	-246
KR4201N7312018-07 콜312.5							1,078
기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	293	289	283	275	263	250	234
-5.33%	280	268	253	235	214	190	165
-2.67%	234	209	181	150	118	84	49
0%	122	82	42	0	-42	-85	-129
2.67%	-92	-140	-187	-234	-281	-328	-375
5.33%	-424	-467	-512	-557	-602	-648	-694
8.00%	-858	-890	-924	-960	-998	-1,038	-1,078

**4. 파생상품의 최대손실예상금액(VaR : 99%신뢰수준,10일기준)**

(단위:백만원)

**5,073**

공시일	2018-06-26
기준일	2018-06-25

## 유로커버드콜모(주식혼합-파생형)

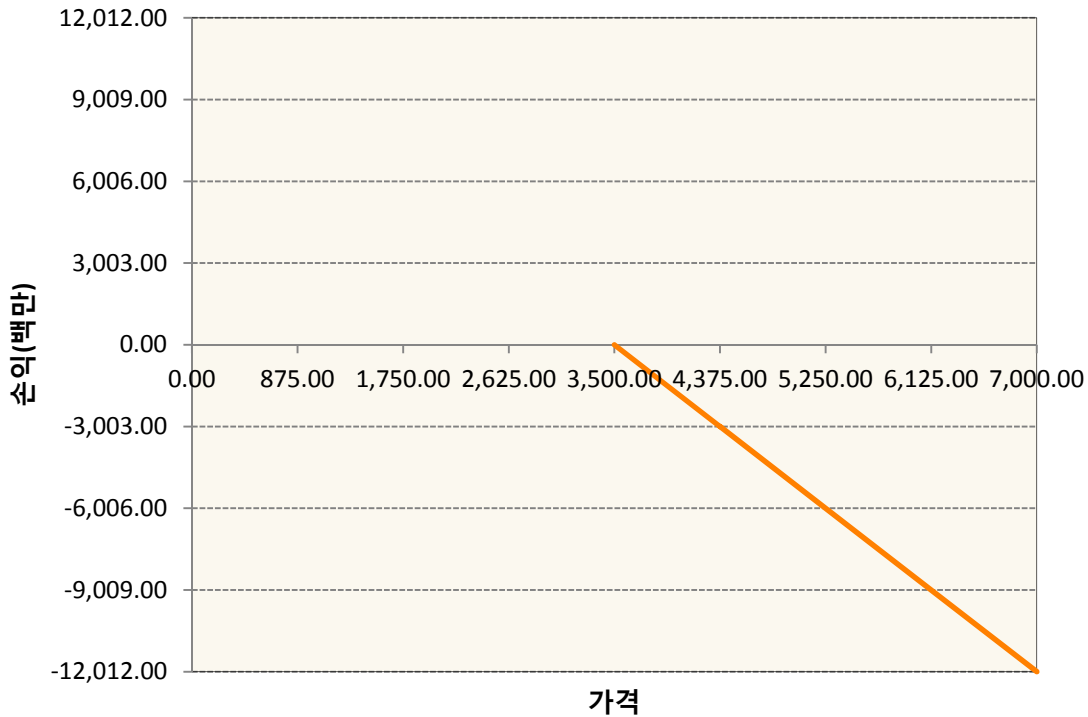
### 1. 계약금액

(단위:백만원)

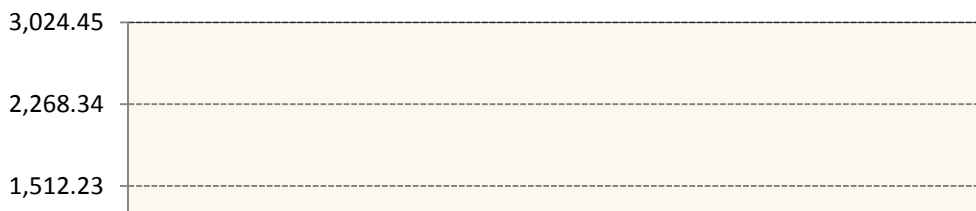
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
신규	유가증권	스왑	0	0	0	장외
신규	유가증권	옵션	0	0	0	장내
신규	지수	스왑	0	0	0	장외
누계	유가증권	선물	7,579	0	7,579	
누계	유가증권	스왑	44,408	0	44,408	장외
누계	유가증권	옵션	0	30,073	-30,073	장내
누계	지수	스왑	52,000	0	52,000	장외

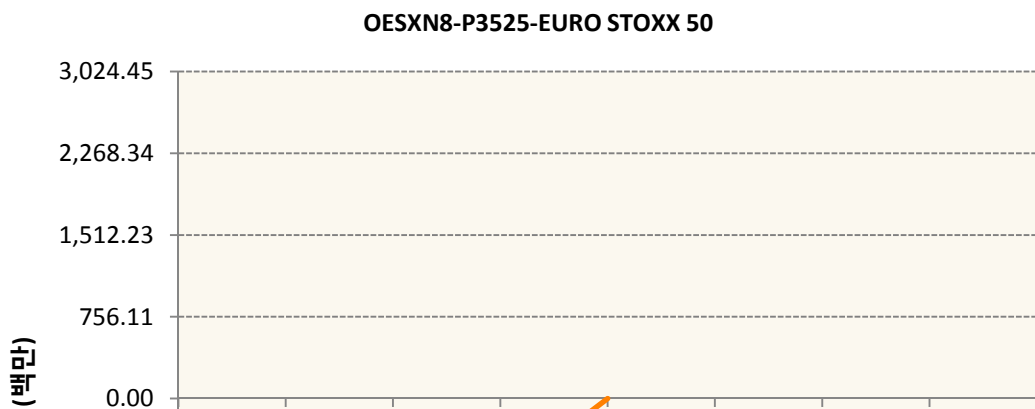
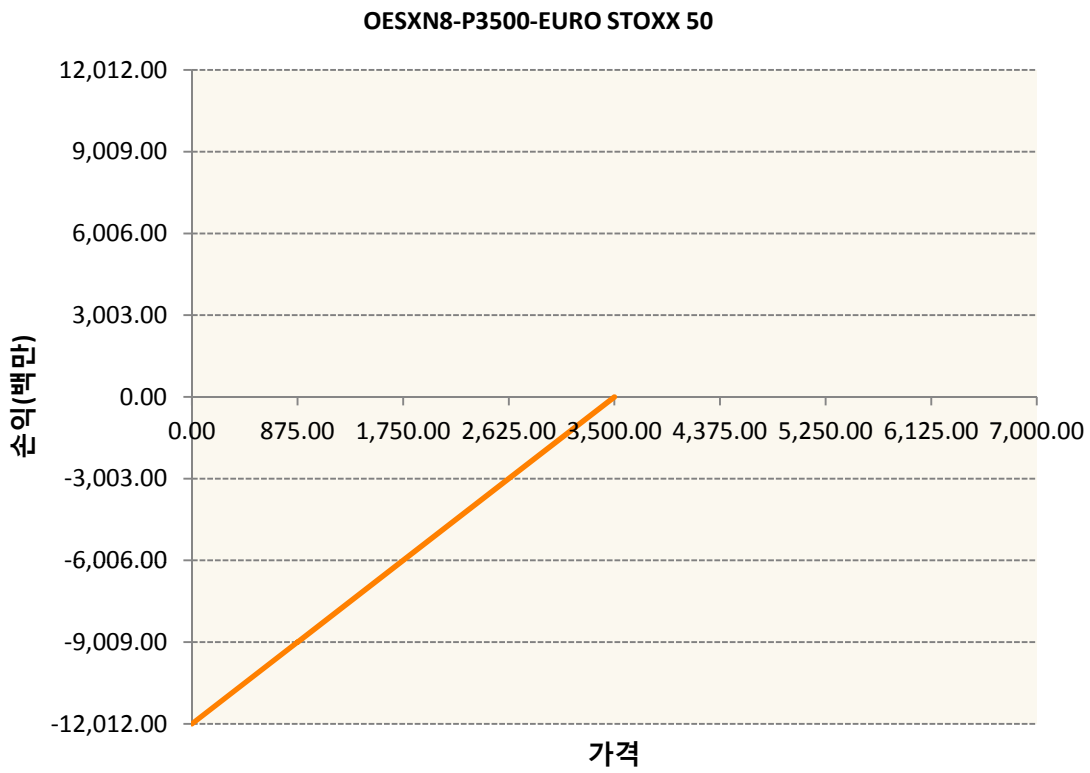
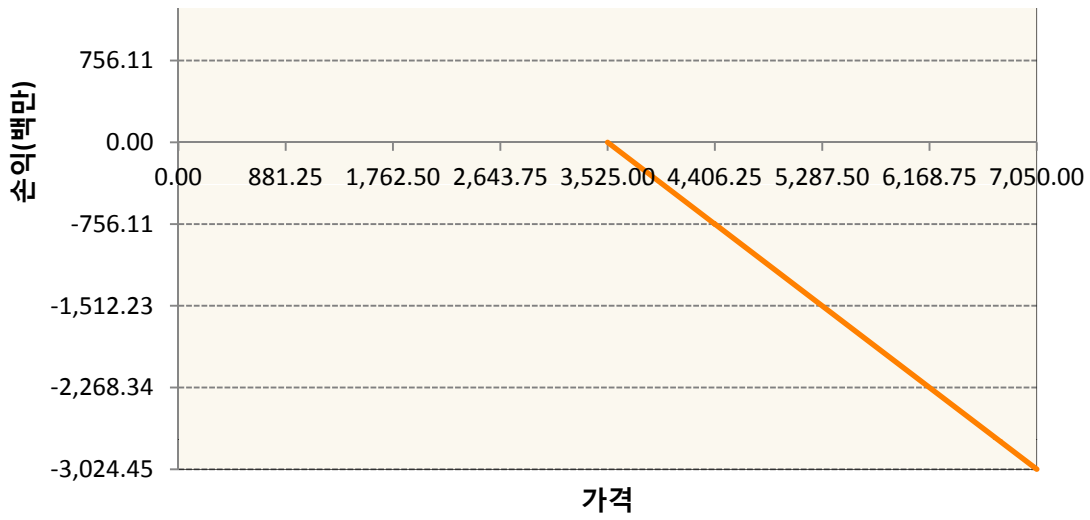
### 2. 만기시점의 손익구조

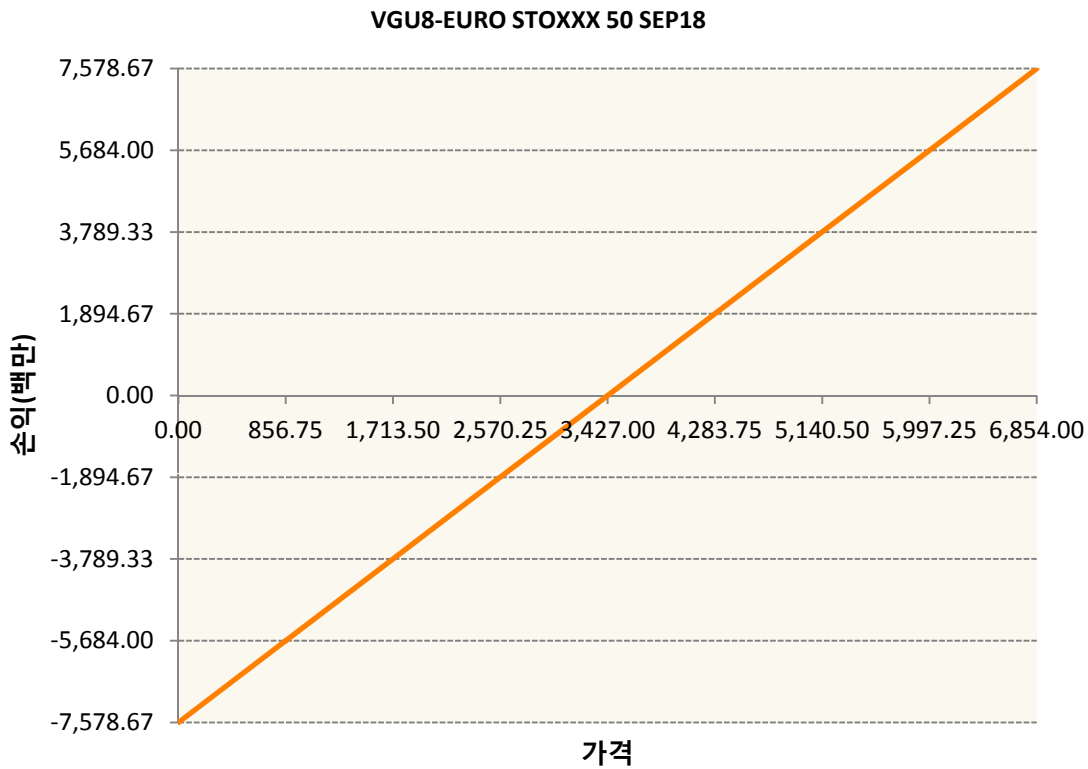
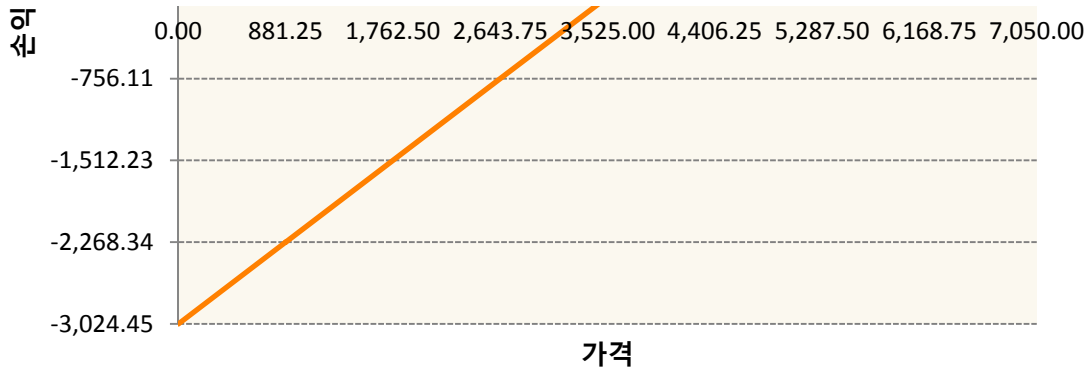
**OESXN8-C3500-EURO STOXX 50**



**OESXN8-C3525-EURO STOXX 50**







3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)		(단위:백만원)
260105SGPXSG EURO Covered CALL STRATEGY -	994.569	0
260105SQPXSG EURO Covered CALL STRATEGY		0
OESXN8-C3!EURO STOXX 50		961
OESXN8-C3!EURO STOXX 50		242
OESXN8-P3!EURO STOXX 50		961
OESXN8-P3!EURO STOXX 50		242
VGU8	EURO STOXXX 50 SEP18	606

4. 파생상품의 최대손실예상금액(VaR : 99%신뢰수준,10일기준) (단위:백만원)





4. 파생상품의 최대손실예상금액(VaR : 99%신뢰수준,10일기준)

(단위:백만원)

1,157



4. 파생상품의 최대손실예상금액(VaR : 99%신뢰수준,10일기준)

(단위:백만원)

81



4. 파생상품의 최대손실예상금액(VaR : 99%신뢰수준,10일기준)

(단위:백만원)

126



4. 파생상품의 최대손실예상금액(VaR : 99%신뢰수준,10일기준)

(단위:백만원)

174

공시일	2018-06-26
기준일	2018-06-25

## 스마트KRX300인덱스목표전환형1

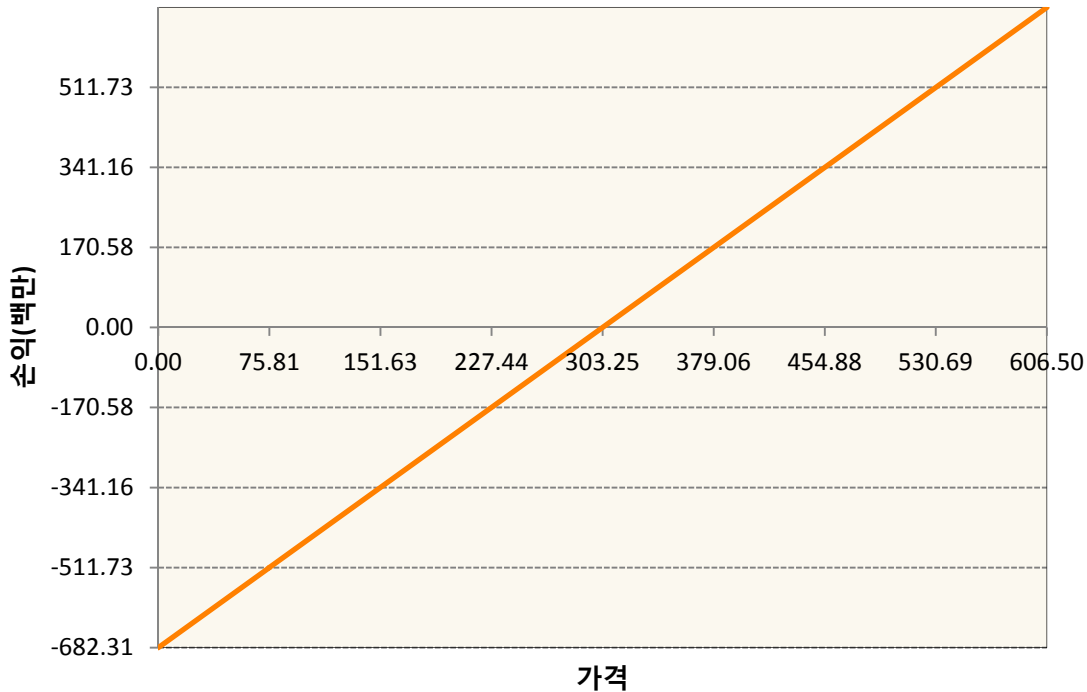
### 1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	682	0	682	장내

### 2. 만기시점의 손익구조

KR4101N90006-2018-09 코스피200지수선물



### 3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

KR4101N90C 2018-09 코스피200지수선물

55

가격	기초자산의 변동성						
	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-55	-55	-55	-55	-55	-55	-55
-5.33%	-36	-36	-36	-36	-36	-36	-36
-2.67%	-18	-18	-18	-18	-18	-18	-18
0%	0	0	0	0	0	0	0
2.67%	18	18	18	18	18	18	18
5.33%	36	36	36	36	36	36	36
8.00%	55	55	55	55	55	55	55

4. 파생상품의 최대손실예상금액(VaR : 99%신뢰수준,10일기준)

(단위:백만원)

41

공시일	2018-06-26
기준일	2018-06-25

## 리디파인K200(주식혼합-파생재간

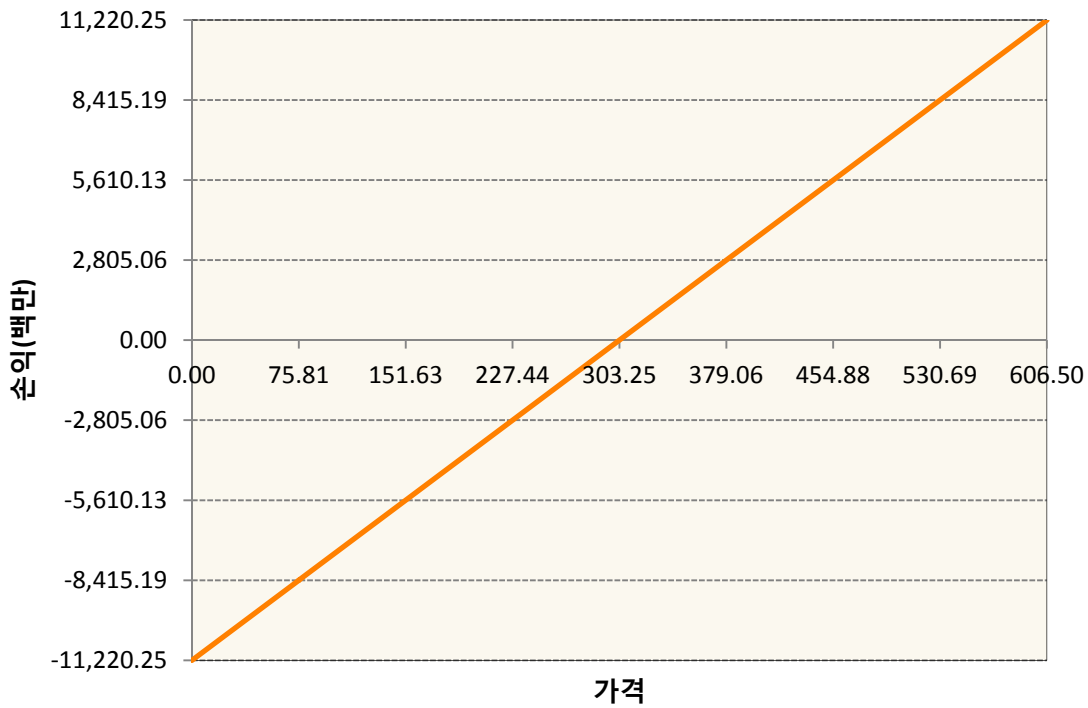
### 1. 계약금액

(단위:백만원)

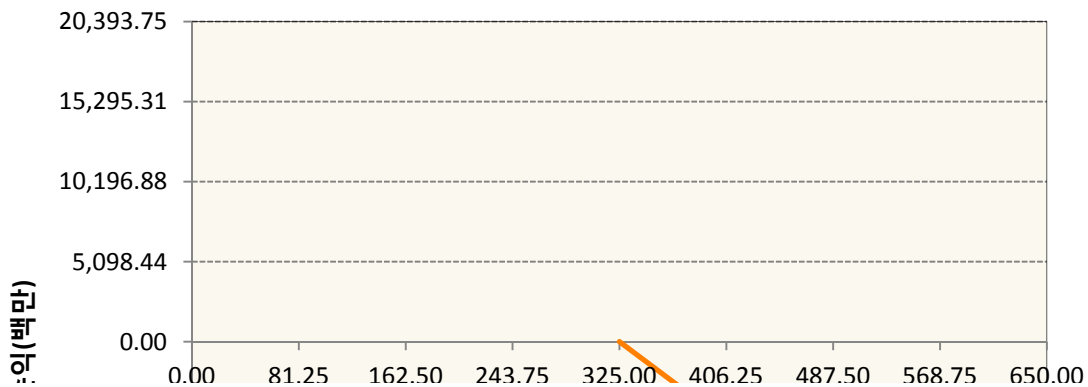
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
신규	유가증권	옵션	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	11,220	0	11,220	장내
누계	유가증권	옵션	0	20,394	-20,394	장내

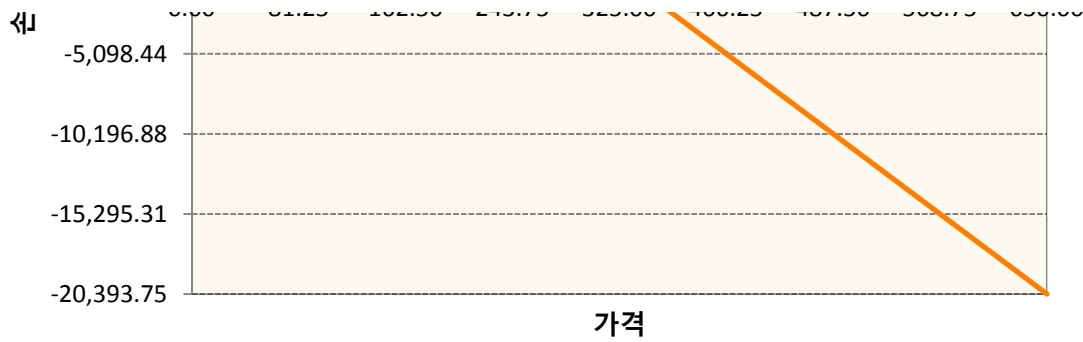
### 2. 만기시점의 손익구조

KR4101N90006-2018-09 코스피200지수선물



KR4201N73257-2018-07 콜325





**3. 시나리오 별 손익구조변동(최대손실예상금액)** (단위:백만원)

KR4101N90C 2018-09 코스피200지수선물 898

기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-898	-898	-898	-898	-898	-898	-898
-5.33%	-599	-599	-599	-599	-599	-599	-599
-2.67%	-299	-299	-299	-299	-299	-299	-299
0%	0	0	0	0	0	0	0
2.67%	299	299	299	299	299	299	299
5.33%	599	599	599	599	599	599	599
8.00%	898	898	898	898	898	898	898

KR4201N732 2018-07 콜325 654

기초자산의 변동성							
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	95	95	94	92	88	83	77
-5.33%	94	92	88	82	74	64	52
-2.67%	87	79	69	56	41	23	3
0%	61	44	23	0	-25	-53	-82
2.67%	-7	-38	-71	-105	-140	-177	-214
5.33%	-150	-192	-234	-276	-318	-361	-404
8.00%	-391	-435	-479	-522	-566	-610	-654

**4. 파생상품의 최대손실예상금액(VaR : 99%신뢰수준,10일기준)** (단위:백만원)

**1,131**

공시일	2018-06-26
기준일	2018-06-25

## 에너지인덱스플러스모(채권-파생형)

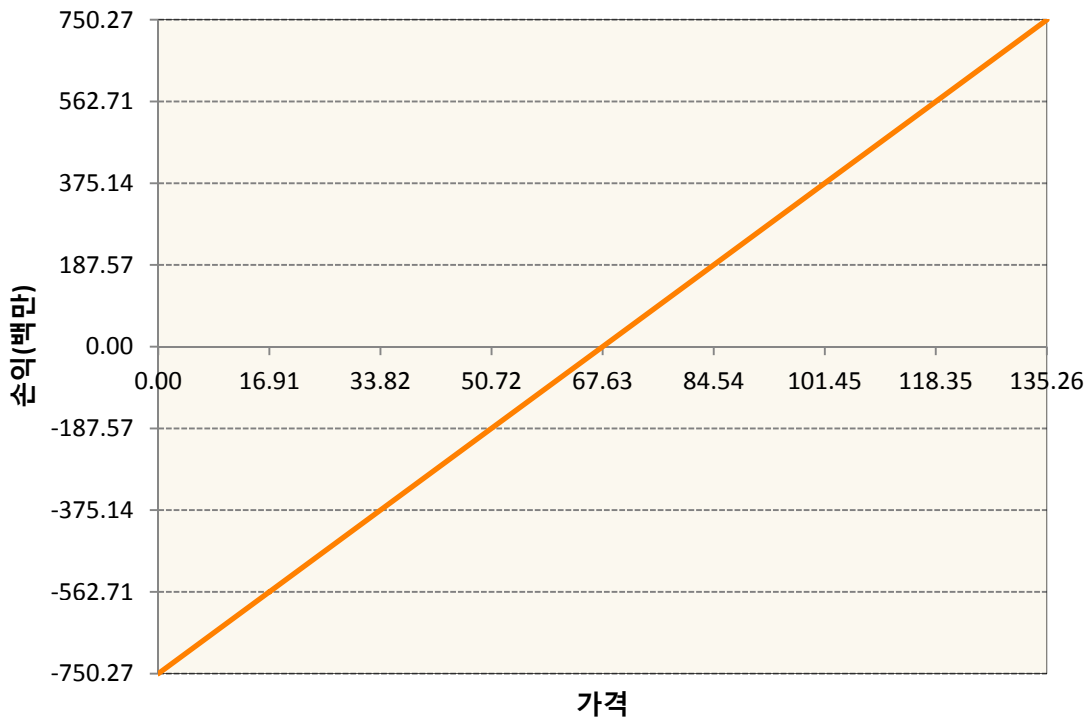
### 1. 계약금액

(단위:백만원)

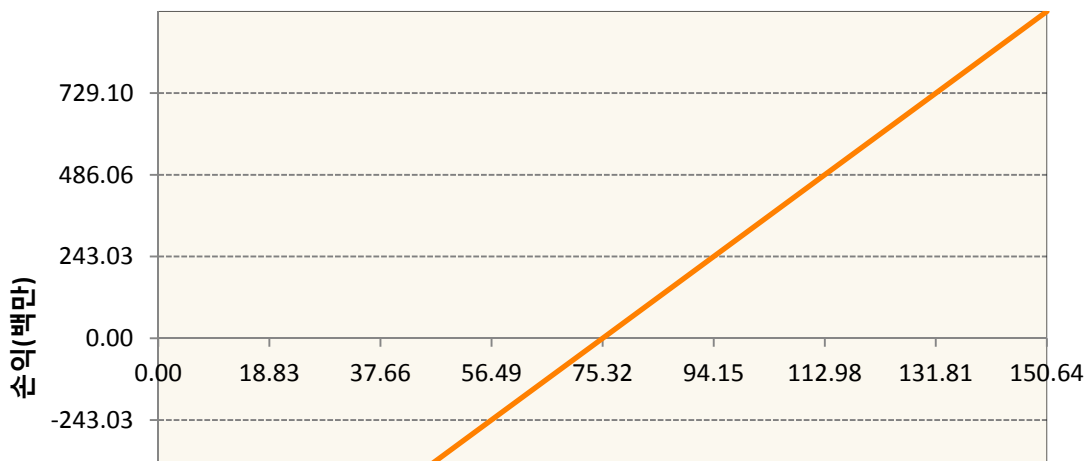
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	유가증권	선물	3,730	614	3,116	

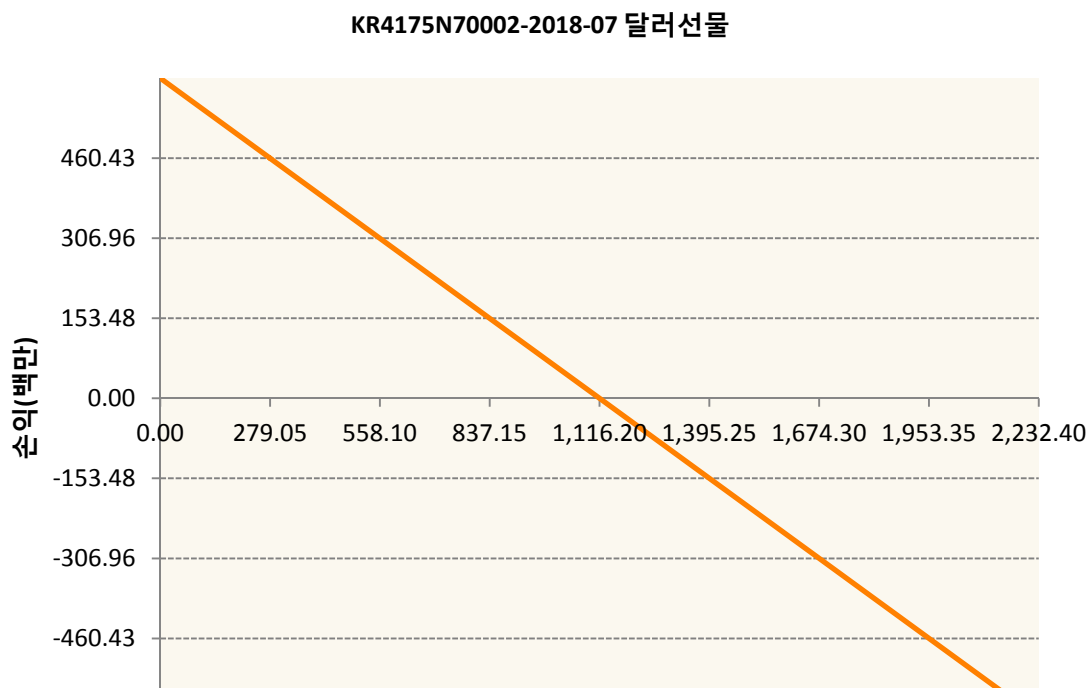
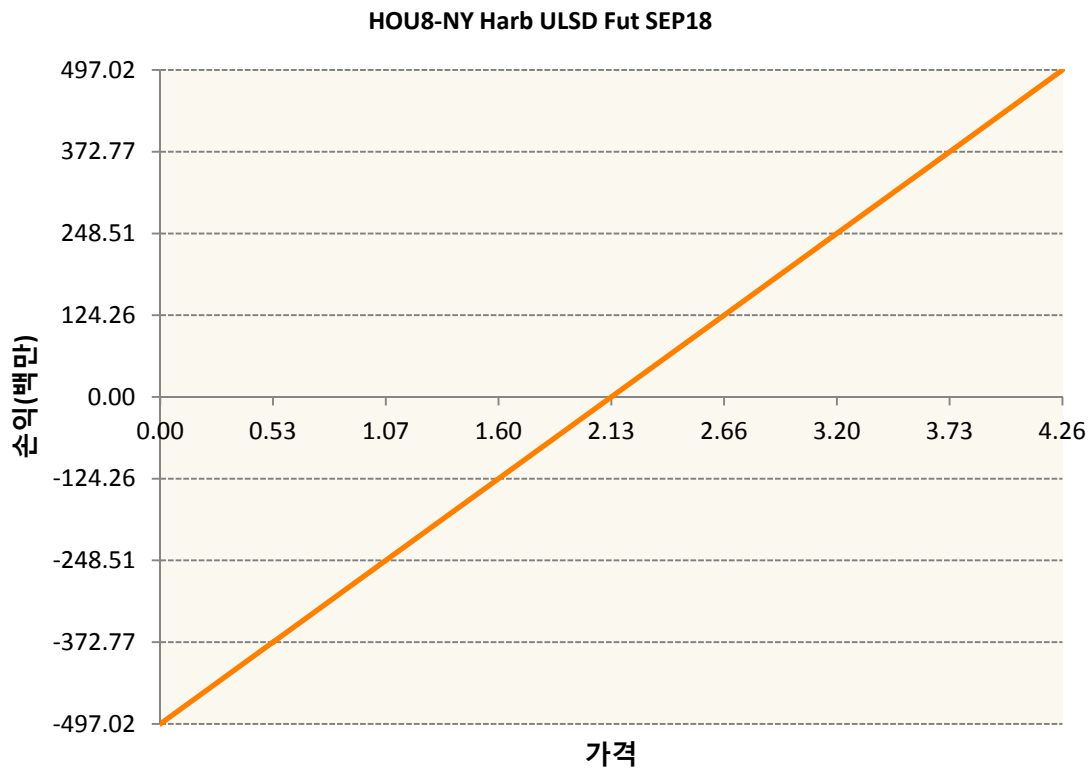
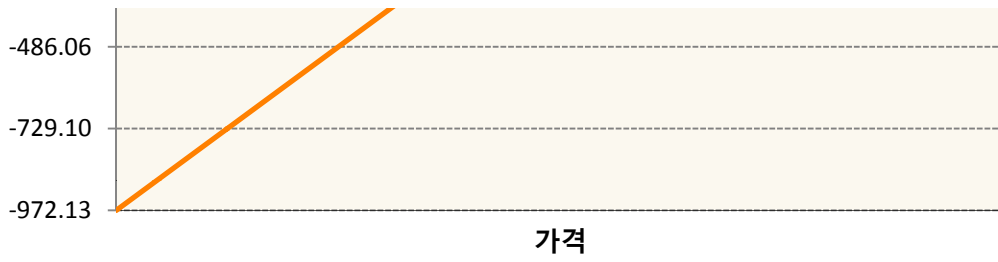
### 2. 만기시점의 손익구조

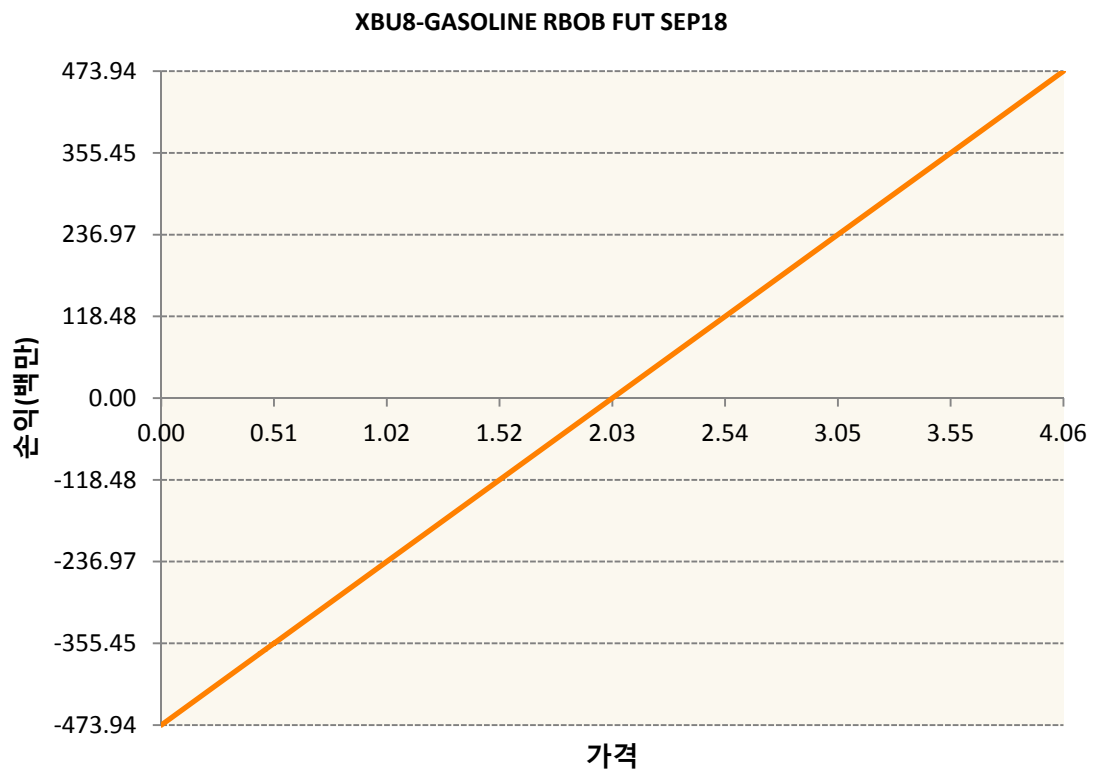
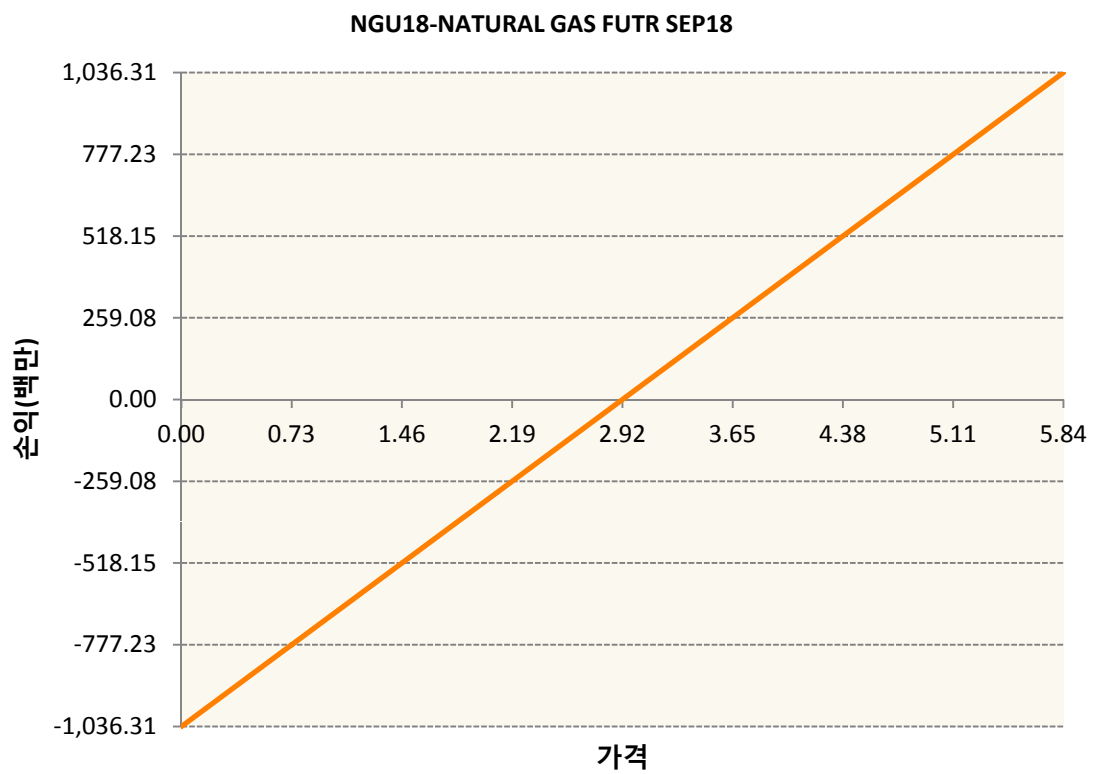
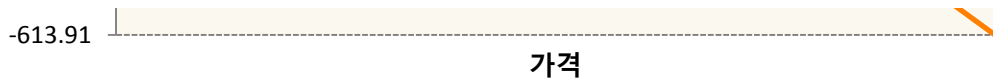
**CLU8-WTI CRUDE FUTURE SEP18**



**COU8-BRENT CRUDE FUTR SEP18**







**3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)** (단위:백만원)

CLU8	WTI CRUDE FUTURE SEP18	60
COU8	BRENT CRUDE FUTR SEP18	78
HOU8	NY Harb ULSD Fut SEP18	40
KR4175N70C	2018-07 달러선물	49
NGU18	NATURAL GAS FUTR SEP18	83
XBU8	GASOLINE RBOB FUT SEP18	38

**4. 파생상품의 최대손실예상금액(VaR : 99%신뢰수준,10일기준)** (단위:백만원)

**438**

공시일	2018-06-26
기준일	2018-06-25

## 애그리컬처인덱스플러스모(채권-파생형)

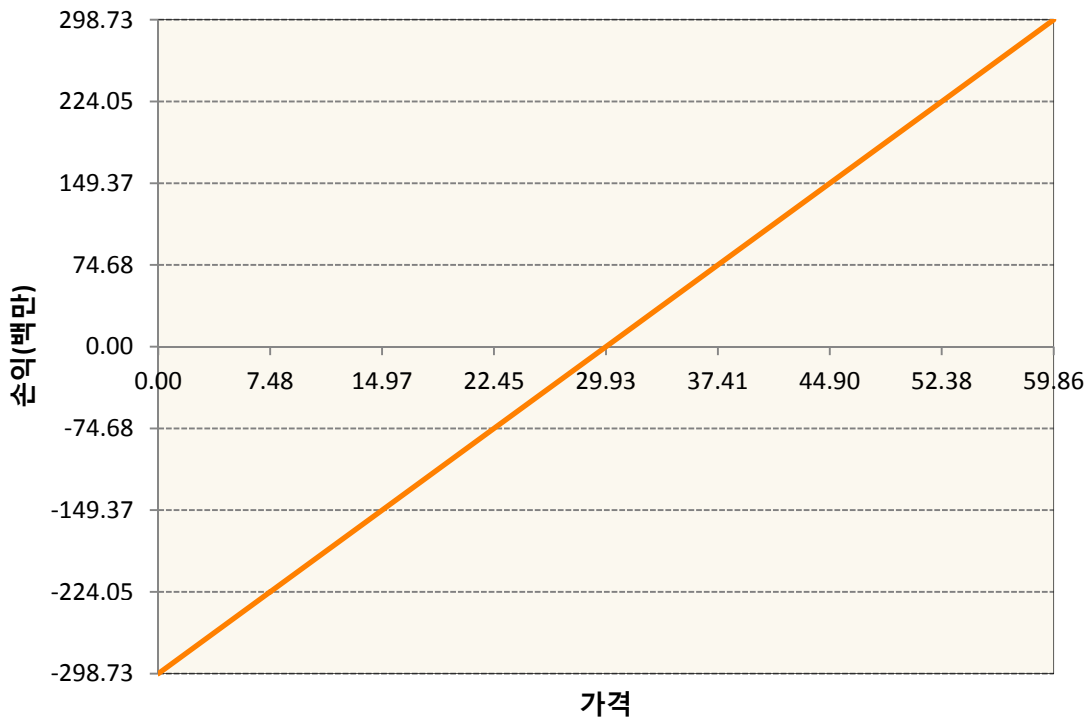
### 1. 계약금액

(단위:백만원)

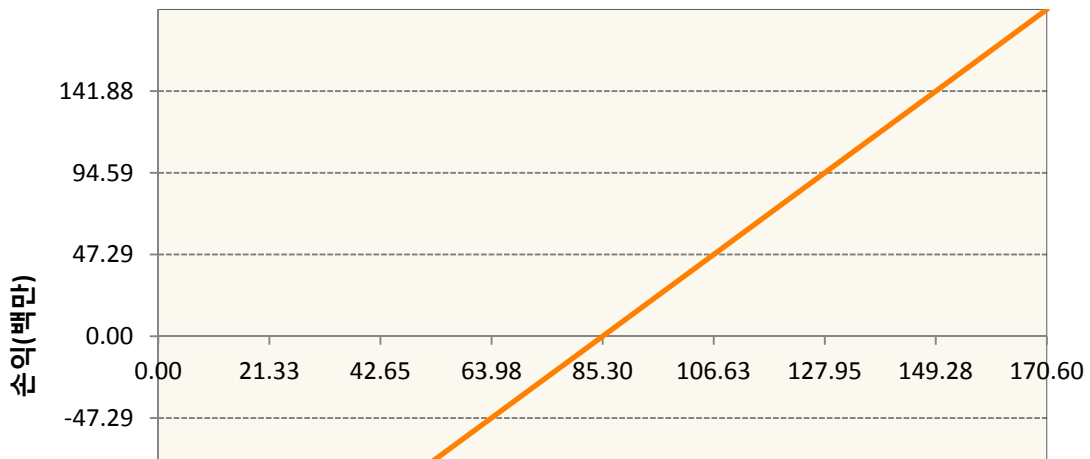
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	유가증권	선물	3,789	112	3,678	

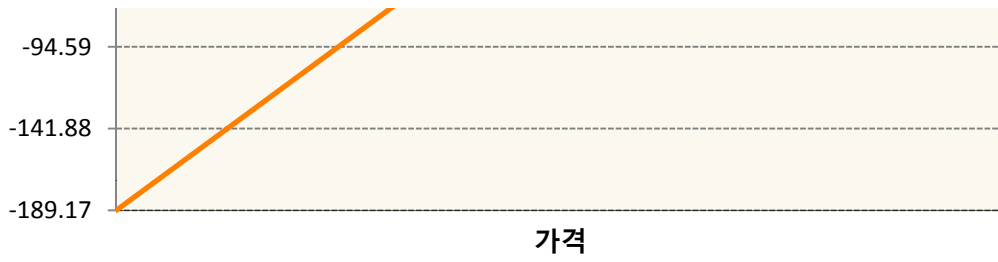
### 2. 만기시점의 손익구조

**BOZ8-SOYBEAN OIL FUTR DEC18**

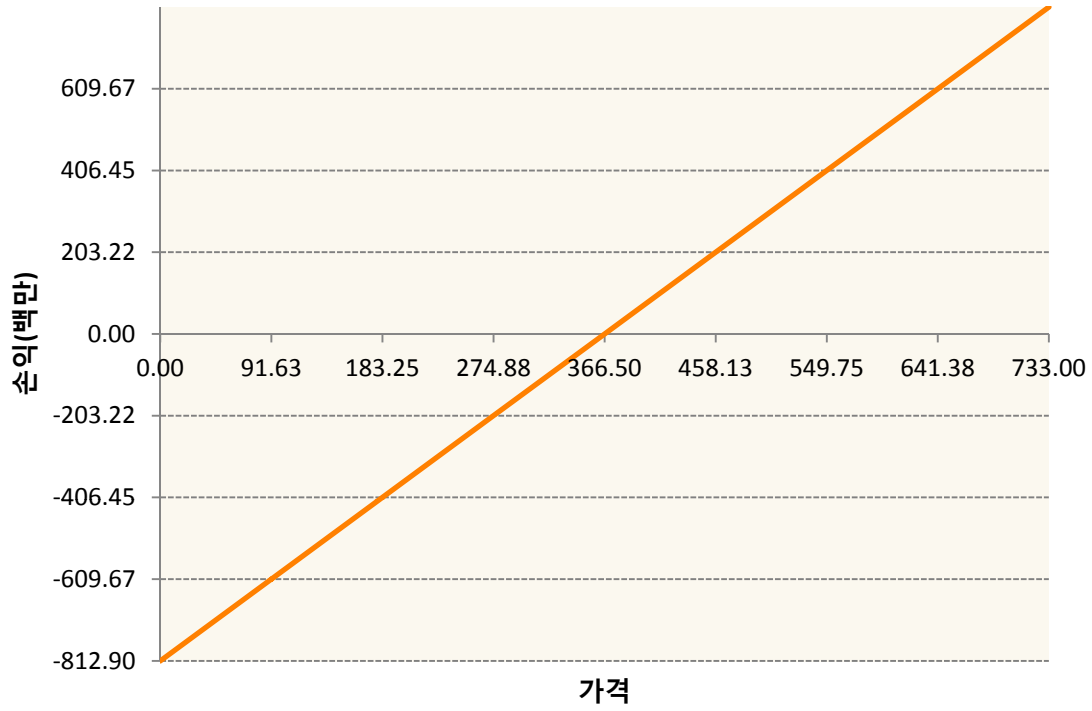


**CTZ8-COTTON NO.2 FUTR DEC18**

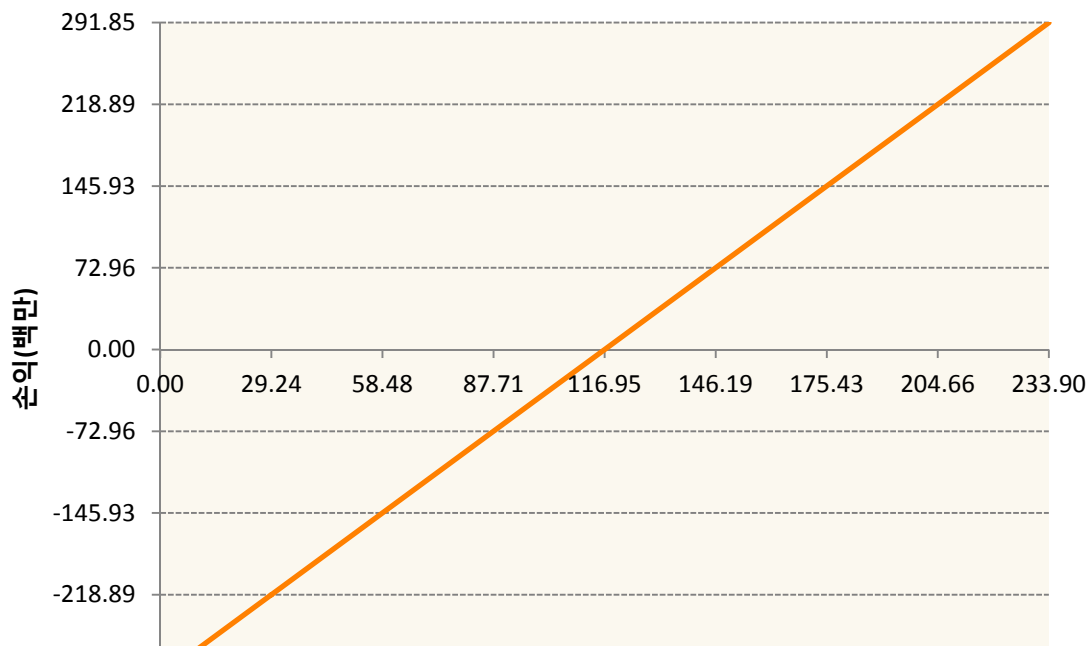


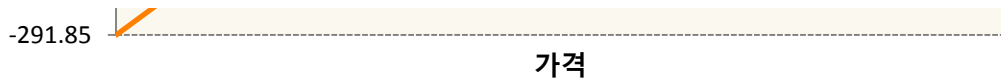


**CU8-CORN FUTURE SEP18**

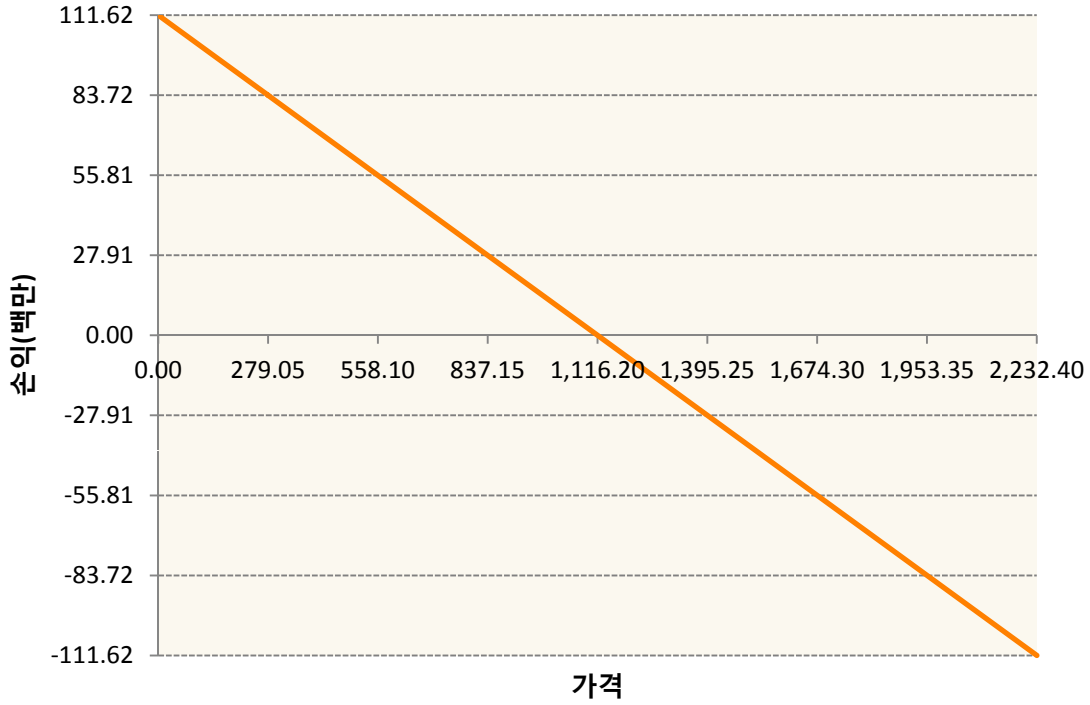


**KCU8-COFFEE 'C' FUTURE SEP18**

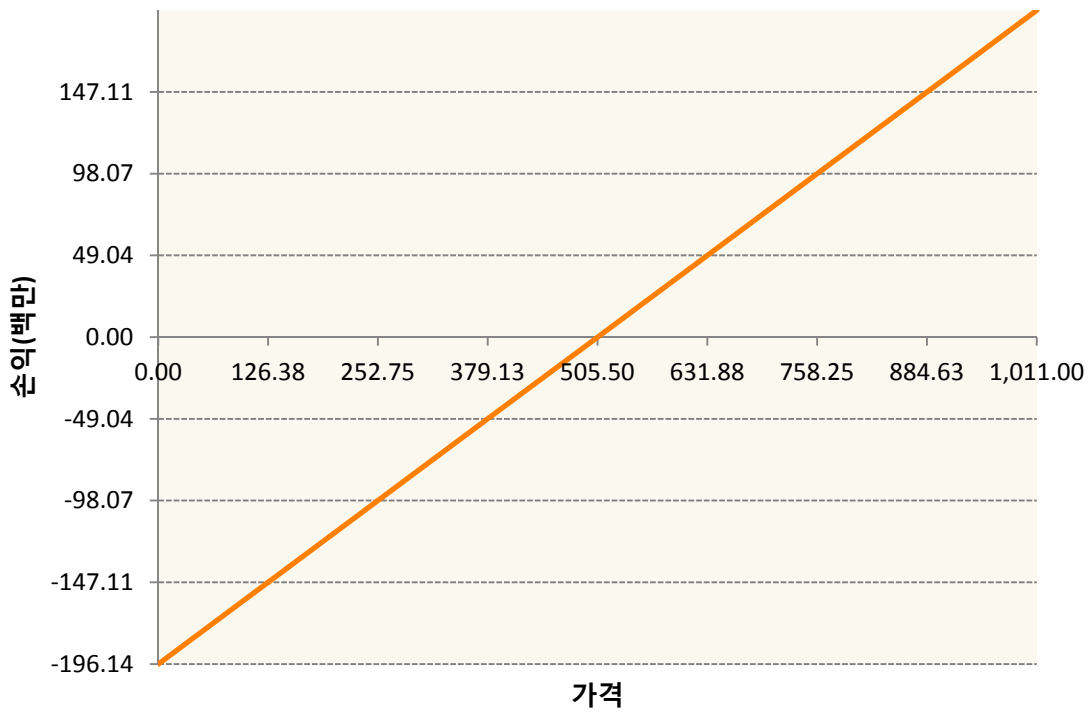




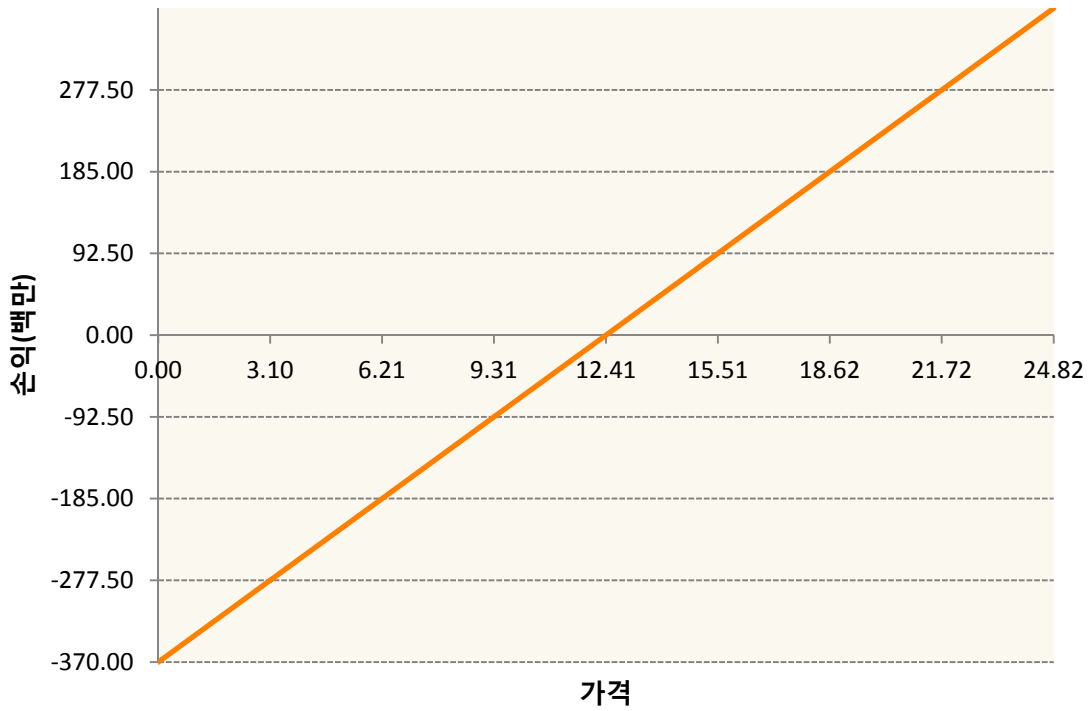
KR4175N70002-2018-07 달러선물



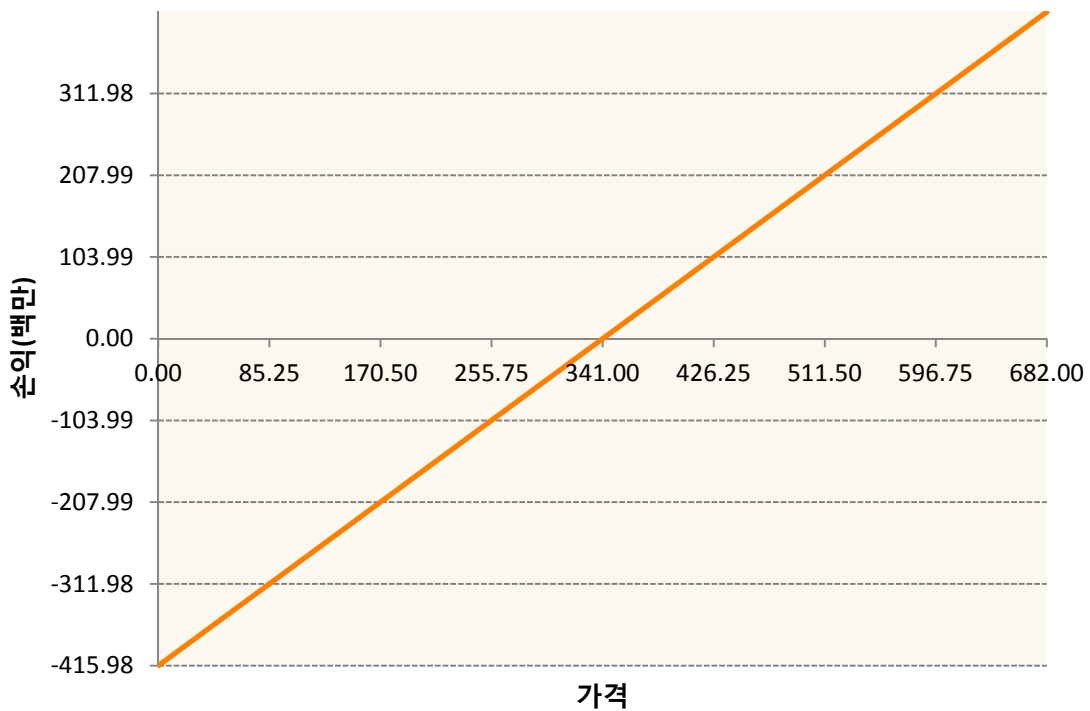
KWU8-KC HRW WHEAT FUT SEP18



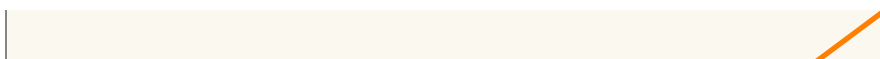
SBV8-SUGAR #11 (WORLD) OCT18

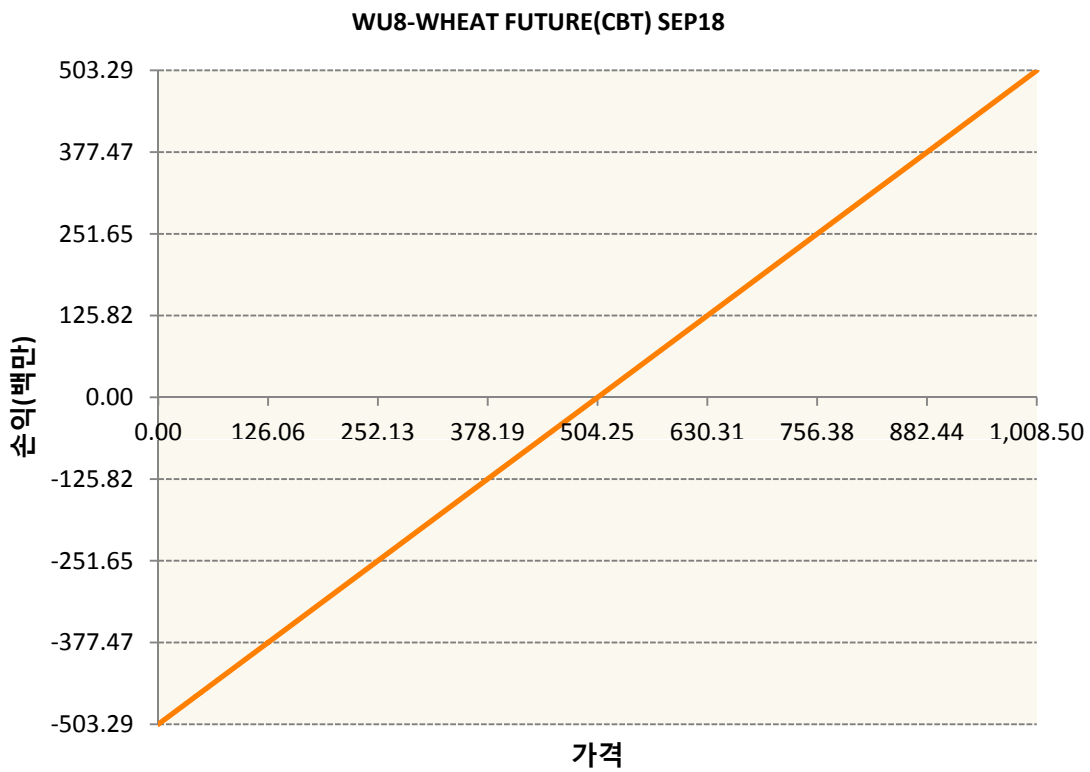
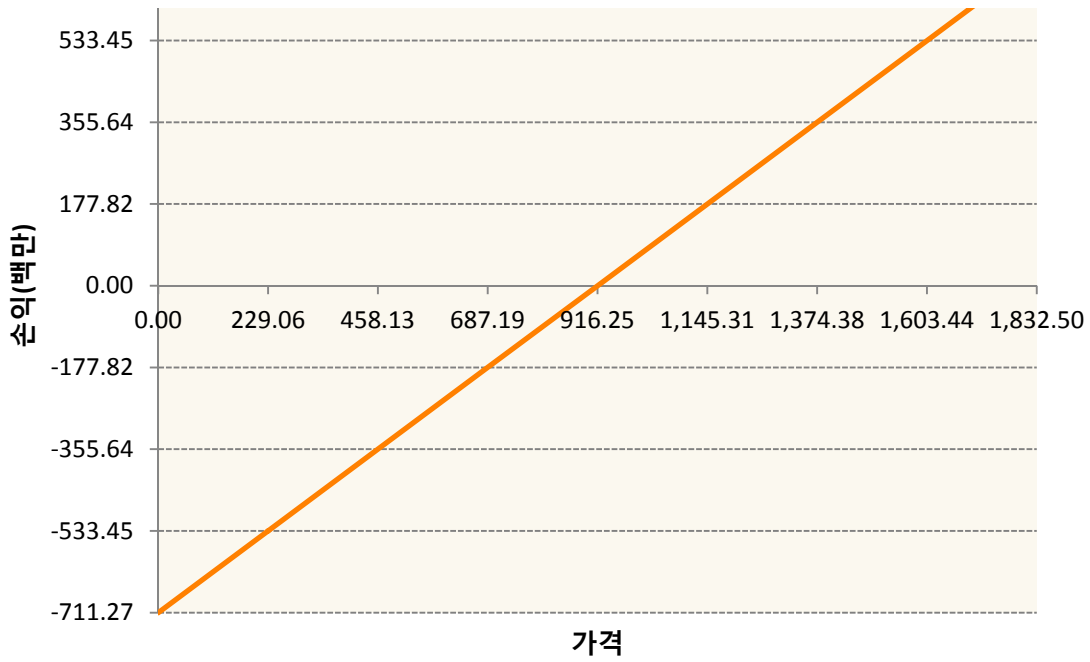


SMZ8-SOYBEAN MEAL FUTR DEC18



SX8-SOYBEAN FUTURE NOV18





**3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)**

(단위:백만원)

BOZ8	SOYBEAN OIL FUTR DEC18	24
CTZ8	COTTON NO.2 FUTR DEC18	15
CU8	CORN FUTURE SEP18	65
KCU8	COFFEE 'C' FUTURE SEP18	23
KR4175N70C	2018-07 달러선물	9

KWU8	KC HRW WHEAT FUT SEP18	16
SBV8	SUGAR #11 (WORLD) OCT18	30
SMZ8	SOYBEAN MEAL FUTR DEC18	33
SX8	SOYBEAN FUTURE NOV18	57
WU8	WHEAT FUTURE(CBT) SEP18	40

**4. 파생상품의 최대손실예상금액(VaR : 99%신뢰수준,10일기준)**

(단위:백만원)

**309**